

2001-05-23

TA

SCB:s bibliotek
Box 24 300
S-104 51 STOCKHOLM

MEDDELANDEN

FM 37 SM 0102

Värdepappersfonderna 1:a kvartalet 2001

Mutual funds – first quarter 2001

I korta drag

9,7 mdkr nettosparades i fonder 1:a kvartalet 2001

Det sammanlagda värdet för fonder registrerade i Sverige minskade under första kvartalet 2001 från 767,8 mdkr till 688,9 mdkr. Då nettoköpen av fondandelar, inkl. återinvesterade utdelningar, var 9,7 mdkr innebär detta att den genomsnittliga värdeförändringen var minus 11,5 procent. Under första kvartalet sjönk generalindex med 18,4 procent. Nettoköpen av fondandelar totalt, 9,7 mdkr, var 51,6 mdkr lägre än föregående kvartal, vilket beror på de stora insättningarna i premiepensionssystemet föregående kvartal. Om sparandet i premiepensionssystemet exkluderas var sparandet 0,5 mdkr lägre än föregående kvartal och 14,9 mdkr lägre än motsvarande kvartal förra året.

Fondförsäkring ökar – direktsparatet från hushållen minskar

Nettosparandet i livförsäkringsanknutna fonder, s.k. unit-linked uppgick till 7,1 mdkr, vilket är en ökning jämfört med föregående kvartal då det uppgick till 7,0 mdkr. Under första kvartalet 2000 uppgick nettosparandet i unit-link till 11,4 mdkr.

Hushållen nettosålde fondandelar för 2,9 mdkr under första kvartalet 2001, vilket är det lägsta sparandet sedan 1995. Förra kvartalet uppgick hushållens sparande till 0,2 mdkr och motsvarande kvartal förra året 5,1 mdkr. Hushållens fondförmögenhet har minskat med 56,7 mdkr under kvartalet, från 413,1 till 356,4 mdkr.

Kraftig minskning av sparandet i aktiefonder

Största delen av det totala fondsparandet under första kvartalet gick till räntefonder, 56,3 procent. Aktiefonder minskade sin andel kraftigt från 50,0 procent till 8,9 procent. Aktiefonderna minskade sin andel av den totala fondförmögenheten under kvartalet från 72,4 till 69,3 procent. Räntefondernas andel ökade med 1,8 procentenheter medan andra fonder ökade sin andel, från 20,1 till 21,4 procent. Antal aktiva fonder var i princip oförändrat och uppgick till 546 vid slutet av första kvartalet.

Statistiska centralbyrån
Statistics SwedenHans Olsson, SCB, tfn 08-506 942 29, hans.olsson@scb.se

Statistiken har producerats av SCB på uppdrag av Finansinspektionen, som ansvarar för officiell statistik inom området.

ISSN 1402-2125 Serie FM – Finansmarknad 37 SM 0102. Utkom den 18 maj 2001.

Tidigare publicering: Se avsnittet Fakta om statistiken.

Utgivare av Statistiska meddelanden är Svante Öberg, SCB.

Innehåll

Tabeller	3
1. Antal aktiva fonder	3
2. Fondförmögenhet, mkr	3
3. Nettosparande inkl. återinvesterad utdelning fördelat på sektorer, mkr	3
4. Fondförmögenhet fördelat på sektorer, mkr	4
5. Bruttosparande i fonder, totalt, fördelat på fondtyp, mkr	4
6. Bruttosparande i fonder, hushåll, fördelat på fondtyp, mkr	5
7. Placeringar, fonder totalt, mkr	6
 Diagram	 7
1. Nettosparande, totalt exkl. hushåll samt hushåll, mdkr	7
2. Nettosparande, fördelat på fondtyp, mdkr	7
3. Fondtypernas andel av det totala fondvärdet, 688,9 mdkr 1:a kvartalet 2001	8
 Fakta om statistiken	 9
Detta omfattar statistiken	9
Definitioner och förklaringar	9
Så görs statistiken	9
Statistikens tillförlitlighet	9
Bra att veta	9
Annan statistik	10
 In English	 11
Summary	11
List of tables	11

Tabeller

1. Antal aktiva fonder

1. Number of active funds

		01kv1	00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	99kv4	99kv3
Aktiefonder	<i>Equity funds</i>	345	345	341	309	295	288	271
Räntefonder	<i>Bond and money market funds</i>	90	90	90	89	89	89	85
Andra fonder	<i>Other funds</i>	111	110	79	64	60	54	52
SUMMA	TOTAL	546	545	510	462	444	431	408

2. Fondförmögenhet, mkr

2. Market value of funds, SEK million

		01kv1	00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	99kv4	99kv3
Aktiefonder	<i>Equity funds</i>	477 396	556 219	590 975	585 454	603 497	551 094	412 520
Räntefonder	<i>Bond and money market funds</i>	63 745	57 344	56 609	55 823	55 144	53 099	53 962
Andra fonder	<i>Other funds</i>	147 708	154 222	130 048	125 746	130 453	116 095	90 555
SUMMA	TOTAL	688 849	767 785	777 632	767 023	789 094	720 288	557 037

3. Nettosparande inkl. återinvesterad utdelning fördelat på sektorer, mkr

3. Net savings incl. reinvested dividends specified by sector, SEK million

		01kv1	00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	Summa 00kv1-4
Hushåll	<i>Households</i>	-2 895	205	2 443	-274	5 101	7 475
Hushållens ideella organisationer	<i>Non profit institutions serving households</i>	254	-74	-114	1 886	756	2 454
Svenska finansiella företag	<i>Sw. financial corporations</i>	8 831	7 198	6 410	10 920	13 576	38 104
varav unit linked	<i>of which unit linked</i>	7 067	6 968	5 129	8 527	11 434	32 058
Svenska icke finansiella företag	<i>Sw. non-financial corporations</i>	2 062	1 028	892	1 847	2 167	5 934
Kommuner	<i>Local government</i>	419	641	495	445	692	2 273
Socialförsäkring	<i>Social security funds</i>	103	51 592	-	-	-	51 592
varav PPM	<i>of which PPM</i>	101	51 192	-	-	-	51 192
Övriga svenska innehavare	<i>Other domestic owners</i>	61	87	-31	-180	5	-119
Utländska innehavare	<i>Foreign owners</i>	874	672	867	1 079	2 223	4 841
SUMMA	TOTAL	9 709	61 349	10 962	15 723	24 520	112 554

4. Fondförmögenhet fördelat på sektorer, mkr

4. Market value of funds specified by sector, SEK million

	01kv1	00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	99kv4
Hushåll <i>Households</i>	356 425	413 140	454 334	453 621	485 325	452 421
Hushållens ideella organisationer <i>Non profit institutions serving households</i>	35 246	37 651	38 530	38 070	37 496	35 258
Svenska finansiella företag <i>Sw. financial corporations</i>	187 341	201 255	213 189	205 488	196 101	173 443
varav unit linked <i>of which unit linked</i>	149 377	157 280	173 397	168 187	166 782	146 162
Svenska icke finansiella företag <i>Sw. non-financial corporations</i>	40 368	39 975	41 422	40 356	40 823	34 539
Kommuner <i>Local government</i>	6 376	6 481	6 053	6 466	6 397	5 421
Socialförsäkring <i>Social security funds</i>	42 958	48 702	-	-	-	-
varav PPM <i>of which PPM</i>	42 013	47 663	-	-	-	-
Övriga svenska innehavare <i>Other domestic owners</i>	4 808	4 995	5 843	4 988	6 678	6 388
Utländska innehavare <i>Foreign owners</i>	15 327	15 586	18 261	18 034	16 274	12 818
SUMMA TOTAL	688 849	767 785	777 632	767 023	789 094	720 288

5. Bruttosparande i fonder, totalt, fördelat på fondtyp, mkr

5. Gross savings in funds, SEK million

	01kv1	00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	Summa 00kv1-4
Aktiefonder <i>Equity funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	22 842	52 531	26 321	33 596	51 532	163 980
Utbetalt <i>Redemptions</i>	21 981	21 841	17 839	22 746	35 569	97 995
Nettosparande <i>Net savings</i>	861	30 690	8 482	10 850	15 963	65 985
Räntefonder <i>Bond and money market funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	14 266	14 005	6 812	13 584	16 519	50 920
Utbetalt <i>Redemptions</i>	8 799	13 519	6 748	12 933	14 767	47 967
Nettosparande <i>Net savings</i>	5 467	486	64	651	1 752	2 953
Andra fonder <i>Other funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	7 493	39 008	4 733	6 939	11 867	62 547
Utbetalt <i>Redemptions</i>	4 113	8 835	2 317	2 717	5 062	18 931
Nettosparande <i>Net savings</i>	3 380	30 173	2 416	4 222	6 805	43 616
TOTAL TOTAL						
Inbetalt <i>Sales</i>	44 602	105 545	37 866	54 119	79 918	277 410
Utbetalt <i>Redemptions</i>	34 893	44 196	26 904	38 396	55 398	164 893
Nettosparande <i>Net savings</i>	9 709	61 349	10 962	15 723	24 520	112 554

6. Bruttosparande i fonder, hushåll, fördelat på fondtyp, mkr**6. Gross savings in funds, SEK million**

	01kv1	00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	Summa 00kv1-4
Aktiefonder <i>Equity funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	9 634	13 895	13 025	14 240	25 254	66 414
Utbetalt <i>Redemptions</i>	12 710	13 793	11 525	14 436	24 078	63 832
Nettosparande <i>Net savings</i>	-3 076	102	1 500	-196	1 176	2 582
Räntefonder <i>Bond and money market funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	2 534	2 740	2 410	2 632	5 646	13 428
Utbetalt <i>Redemptions</i>	1 944	2 898	1 864	3 426	4 058	12 246
Nettosparande <i>Net savings</i>	590	-158	546	-794	1 588	1 182
Andra fonder <i>Other funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	1 553	1 971	1 528	2 179	5 384	11 062
Utbetalt <i>Redemptions</i>	1 963	1 710	1 131	1 463	3 047	7 351
Nettosparande <i>Net savings</i>	-410	261	397	716	2 337	3 711
TOTAL <i>TOTAL</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	13 721	18 606	16 963	19 051	36 284	90 904
Utbetalt <i>Redemptions</i>	16 616	18 401	14 520	19 325	31 183	83 429
Nettosparande <i>Net savings</i>	-2 895	205	2 443	-274	5 101	7 475

7. Placeringar, fonder totalt, mkr

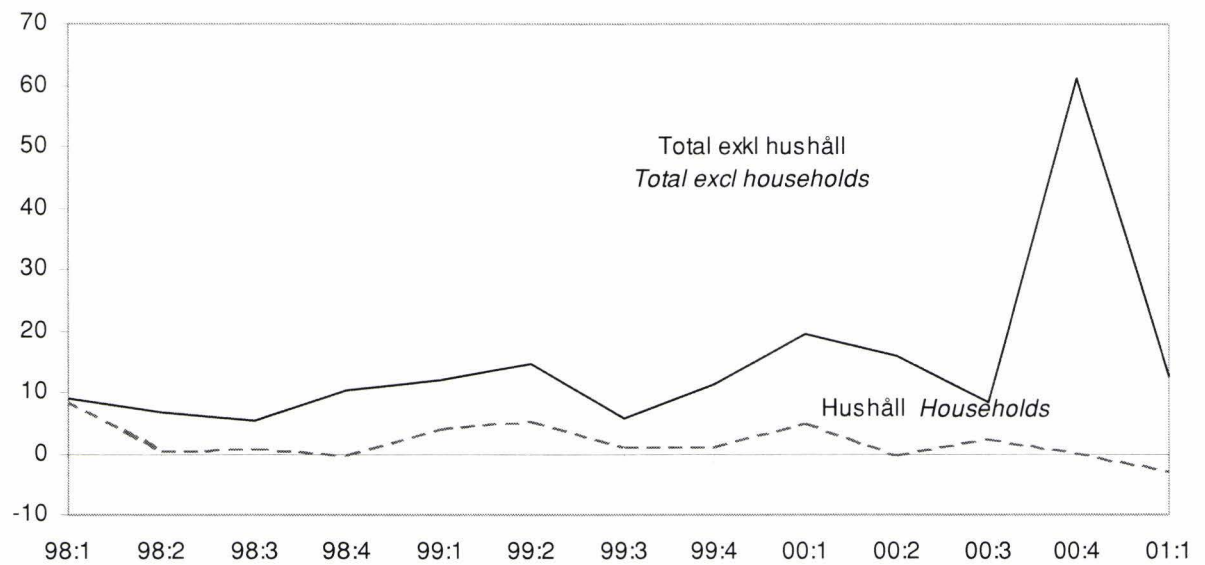
7. Fund investments at market value, total, SEK million

	01kv1	00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	99kv4
Likvida medel <i>Liquid funds</i>	52 741	56 376	42 297	35 449	29 351	25 406
Aktier <i>Shares</i>	532 590	612 682	638 855	636 931	659 992	606 091
Noterade <i>Listed</i>	529 282	610 148	635 430	632 770	650 847	598 897
finansiella företag <i>financial corp.</i>	50 926	65 538	66 045	64 968	54 848	42 735
icke fin. företag <i>non-financial corp.</i>	198 031	231 193	240 494	249 475	268 143	268 751
utländska företag <i>foreign corp.</i>	280 325	313 416	328 891	318 328	327 855	287 410
Onoterade <i>Not listed</i>	3 308	2 534	3 425	4 161	9 146	7 195
finansiella företag <i>financial corp.</i>	30	1	2	51	75	43
icke fin. företag <i>non-financial corp.</i>	1 460	1 556	1 771	2 431	4 012	2 951
utländska företag <i>foreign corp.</i>	1 818	977	1 653	1 679	5 058	4 200
Räntebärande papper	139 167	124 181	112 067	99 668	101 359	96 108
<i>Interest bearing securities</i>						
Certifikat <i>Short term securities</i>	38 529	42 165	40 028	45 828	41 321	39 086
stat <i>central government</i>	32 025	31 536	29 141	32 631	27 140	26 459
kommun <i>local government</i>	0	4	0	0	0	2
finansinstitut <i>financial institutions</i>	1 454	5 947	6 921	8 962	8 757	9 513
övriga svenska <i>other domestic</i>	4 660	4 658	3 957	4 225	5 414	3 103
utlandet <i>rest of the world</i>	391	20	10	10	10	10
Obligationer <i>Long-term securities</i>	100 638	82 016	72 039	53 840	60 037	57 022
stat <i>central government</i>	47 501	49 797	39 277	27 950	36 429	35 001
kommun <i>local government</i>	15	15	15	28	28	29
finansinstitut <i>financial institutions</i>	42 140	26 540	26 023	19 041	18 811	17 104
övriga svenska <i>other domestic</i>	3 088	1 817	1 955	2 069	1 097	1 254
utlandet <i>rest of the world</i>	7 895	3 848	4 768	4 753	3 672	3 635
Andelar i svenska vp-fonder	2 014	2 252	2 550	2 421	2 682	2 416
<i>Dom. mutual funds</i>						
Andelar i utländska vp-fonder	670	412	516	713	593	564
<i>Foreign mutual funds</i>						
Derivatinstrument <i>Derivatives</i>	681	1 410	1 567	232	2 731	3 845
SUMMA TOTAL	727 864	797 312	797 853	775 415	796 708	734 430
därav övriga fordringar/skulder <i>of which other claims/debts</i>	-39 015	-29 527	-20 221	-8 391	-7 614	-14 141
Fondernas värde	688 849	767 785	777 632	767 023	789 094	720 288
<i>Market value of funds</i>						

Diagram

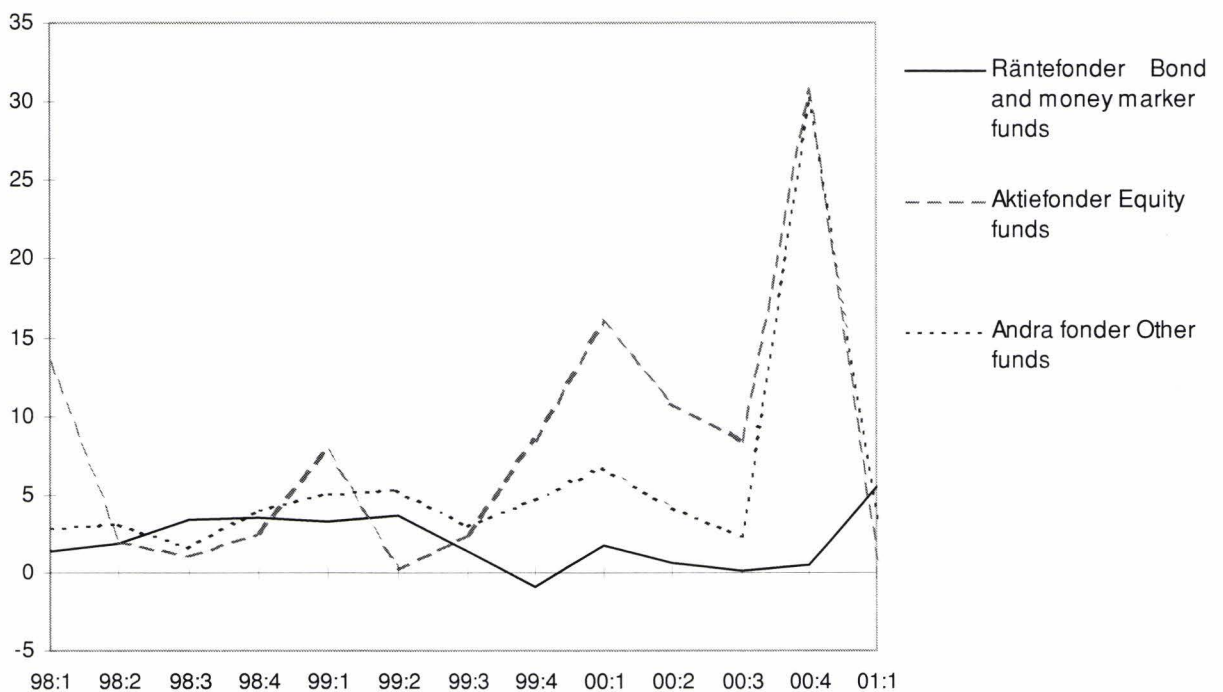
1. Nettosparande, totalt exkl. hushåll samt hushåll, mdkr

1. Net savings, total excl. households and households, SEK billion



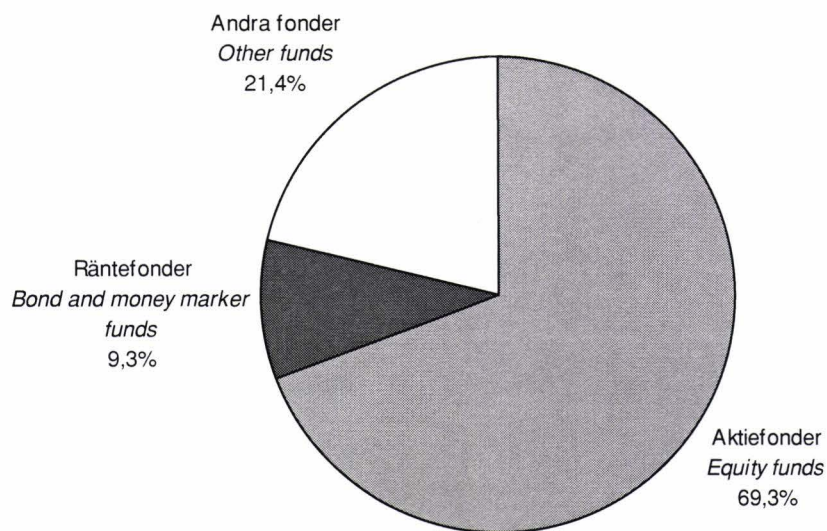
2. Nettosparande, fördelat på fondtyp, mdkr

2. Net savings, by type of fund, SEK billion



3. Fondtypernas andel av det totala fondvärdet, 688,9 mdkr 1:a kvartalet 2001

3. Type of fund as a proportion of the total value of funds, 688.9 SEK billion, first quarter 2001



Fakta om statistiken

Detta omfattar statistiken

Undersökningen sker kvartalsvis och omfattar alla värdepappersfonder som står under Finansinspektionens tillsyn. Här ingår även fonder som inte är öppna för allmänheten. Per 2001-03-31 var antalet aktiva fonder 546. Undersökningen täcker ej in utlandsregistrerade fonder. De marknadsförs och säljs i Sverige men fondföretaget har sitt säte i ett annat land. Informationskraven som gäller i fondföretagets hemland gäller då för fonden, enligt 7b §, lagen (1990:1114) om värdepappersfonder.

Definitioner och förklaringar

Från och med fjärde kvartalet 1991 görs även en uppdelning på typ av fond. Uppdelningen som följer Finansinspektionens författningssamling, gör det lättare att få en rättvis bild av fonderna då det finns stora skillnader inom gruppen, framför allt vad gäller riskspridning. Det finns fyra typer av fonder. Allemansfonder är fonder bildade enligt 10 § lagen (1983:890) om allemanssparande. Då denna lag är upphävd skiljer vi inte ut allemansfonder från aktiefonder fr.o.m. första kvartalet 1999. Till aktiefonder hör de fonder som enligt sin placeringsinriktning har minst 75 procent av värdepappersinnehavet placerade i svenska eller utländska aktier. Räntefonder måste ha 100 procent av värdepappersinnehavet placerat i räntebärande papper. Sista typen är andra fonder, som innehåller de fonder som inte kan klassificeras enligt någon av de andra typerna. Nationella fonder har vidare placeringsmöjligheter än värdepappersfonder och behöver inte uppfylla samtliga krav i lagen (1990:1114) om värdepappersfonder. De klassificeras efter sin inriktning och ingår i redovisningen under respektive fondtyp, aktiefond, räntefond eller annan fond. Nationella fonder kallas de eftersom de endast får marknadsföras och säljas i sitt hemland, Sverige i detta fallet.

Teckenförklaring till tabellerna

- Inget finns att redovisa
- . Uppgift kan ej förekomma
- .. Uppgift inte tillgänglig eller alltför osäker för att anges

Så görs statistiken

Svenskregistrerade värdepappersfonder som står under Finansinspektionens tillsyn rapporterar in en detaljerad balansräkning och transaktionsuppgifter varje kvartal. Dessa uppgifter granskas och sammanställs av SCB. Publikationen redovisar totaler samt fördelning på sektorer och fondtyper.

Statistikens tillförlitlighet

Granskning och rimlighetsbedömning utförs kontinuerligt.

Bra att veta

I inrapporteringen skall värdepappersinnehaven marknadsvärderas. Förändringar i ränte- och kursnivåer påverkar därför fördelningen mellan olika balansposter. Underlaget utgörs av rapportformulär, där detaljerade uppgifter om fondernas tillgångar och skulder, transaktioner samt intäkter och kostnader lämnas till

SCB. I denna publikation redovisas endast en del av de uppgifter som finns på rapportformulären. De som önskar mer detaljerade uppgifter på total- eller fondtypsnivå ombedes kontakta Hans Olsson, tfn 08-506 942 29. Från och med andra kvartalet 1998 används ett nytt rapportformulär vilket bland annat innebär att uppgifter till tabell 2 inte finns att få bakåt i tiden. Tabell 4 är omarbetad från och med samma tidpunkt.

Publicera gärna statistiken men var vänlig ange SCB som källa

Annan statistik

Fondbolagens Förening publicerar statistik över värdepappersfondernas transaktioner på månadsbasis. Populationen är dock inte helt överensstämmande. SCB täcker in alla fonder som är sverigeregistrerade medan Fondbolagens Förening täcker in de svensk- och utlandsregistrerade fonder vars fondbolag är medlem i föreningen.

Mer information om statistiken och dess kvalitet ges i en särskild Beskrivning av statistiken på SCB:s webbplats, www.scb.se.

In English

Summary

SEK 9.7 billion in net savings for mutual funds in the first quarter 2001

The outstanding value for mutual funds registered in Sweden decreased during the first quarter 2001 from SEK 767.8 billion to SEK 688.9 billion. Since net savings included reinvested dividends amounting to SEK 9.7 billion, the average decrease in value of the funds was 11.5 percent. During the first quarter, the SX General index declined by 18.4 percent. The total net savings for mutual funds, SEK 9.7 billion, was SEK 51.6 billion less than in the previous quarter, which is due to large savings in the Premium Pension System last quarter. The net savings, excluding the Premium Pension System were SEK 0.5 billion less than last quarter and SEK 14.9 billion less than for the corresponding period last year.

Increasing unit-link saving – direct saving from the household sector decreases

Net savings for unit linked funds amounted to SEK 7.1 billion during the first quarter, which is an increase compared to last quarter when it amounted to SEK 7.0 billion. During the first quarter 2000, net savings in unit-link amounted to SEK 11.4 billion.

Net savings in mutual funds for the household sector were SEK -2.9 billion in the first quarter 2001. This is the lowest rate of savings since 1995. The outstanding value of funds for the household sector decreased from SEK 413.1 to 356.4 billion.

Decreasing savings in equity funds

The dominant amount of net savings in mutual funds during the quarter was in bond and money market funds, 56.3 percent. The share of savings in equity funds as part of the total net savings decreased from 50.0 percent to 8.9 percent during the fourth quarter. The share of equity funds in the total fund value during the quarter decreased from 72.4 to 69.3 percent. The share of other funds increased, from 20.1 to 21.4 percent, while bond and money market funds increased their share by 1.8 percentage points.

The number of active mutual funds amounted to 546 at the end of the first quarter 2001.

List of tables

1. Number of active funds	3
2. Market value of funds, SEK million	3
3. Net savings incl. reinvested dividends specified by sector, SEK million	3
4. Market value of funds specified by sector, SEK million	4
5. Gross savings in funds, SEK million	4
6. Gross savings in funds, SEK million	5
7. Fund investments at market value, total, SEK million	6